

Central Daily Market Report

2021年8月5日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

| 単位：億円 | 2021年8月5日 | | 2021年8月6日 | | 2021年8月10日 | |
|-----------------------|-----------|---------|-----------|--------|----------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 400 | | 300 | | 1,000 | |
| 財政 | 1,400 | | 1,300 | | 1,000 | |
| 資金過不足 | 1,000 | | 1,600 | | 2,000 | |
| 金融調節 | スタート | エンド | スタート | エンド | スタート | エンド |
| 貸出 | | | | | | |
| 全店共通 | | | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | 10,700 | | | | | |
| CP等買入 | | | ▲ 300 | | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| 新型コロナ対応金融支援特別 | | | | | | |
| E T F 買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | | | | | | |
| ※ドル資金供給用担保準備供給 | | | | | | |
| 当預増減 | 11,700 | | 1,300 | | 2,000 | |
| 当座預金残高 | 5,292,900 | | 5,294,200 | | 5,296,200 | |
| 準備預金残高 | 4,638,800 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,638,800 | | | | 8月6日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,638,800 | | | | 積数 | 100 |
| 非準備預金先 | 654,100 | | | | 1日平均 | 0 |
| 積み期間(7/16~8/15)の所要準備額 | | | | | | 3,747,800 |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 100.00% | 日数 | 67.74% | | |

●2021年8月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.06~▲0.02%の調達で始まった。オファー量の減少を背景に、一部調達水準を切り上げる先が見られた。一巡後は▲0.055~▲0.015%と、比較的広いレンジで調整の出合いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

本日はTB6M物(1013回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、複数の業態から発行されたものの、少額が中心であった。発行レートは、低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

| 2021/8/5 | 無担(速報) | | | 有担(速報) | | | 短国 | 東京レポレート | JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|----------|---------|---------|---------|--------|----|----|---------|---------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 単位：% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | | | 平均 | 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替(9時) |
| O/N | ▲ 0.070 | 0.001 | ▲ 0.030 | | | | - | ▲ 0.079 | 0.005 | 0.005 | 27,728.12 | 144.04 | 109.53-54 | 109.56-57 |
| T/N | | | ▲ 0.020 | | | | - | ▲ 0.081 | | | | | | |
| S/N | | | ▲ 0.015 | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.055 | ▲ 0.030 | ▲ 0.051 | | | | - | ▲ 0.084 | | | | | | |
| 2W | | | ▲ 0.028 | | | | - | ▲ 0.088 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.093 | | | | | | |
| 1M | 0.070 | 0.150 | 0.137 | | | | - | ▲ 0.097 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.113 | ▲ 0.103 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.126 | ▲ 0.116 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.126 | ▲ 0.130 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 7/29 | 7/30 | 8/2 | 8/3 | 8/4 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 5,372,300 | 5,388,800 | 5,373,300 | 5,356,200 | 5,281,200 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 4,675,400 | 4,691,600 | 4,701,800 | 4,693,400 | 4,638,800 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 6,592,500 | 6,608,800 | 6,592,500 | 6,575,400 | 6,500,300 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.043% | ▲0.044% | ▲0.043% | ▲0.041% | ▲0.039% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 156,558 | 159,181 | 155,959 | 146,969 | 142,809 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 137,024 | 138,396 | 136,620 | 127,250 | 122,497 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 76,278 | 79,515 | 75,579 | 64,149 | 61,466 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 19,534 | 20,785 | 19,339 | 19,719 | 20,312 |

●入札結果

| 名称 | 回号 | 表面利率 | 発行予定額 | 発行日 | 償還日 | 応募額(億円) | 募入額(億円) | 募入最低額 | 募入最高利回・利回差 | 案分率 | 募入平均価格 | 募入平均利回・利回差 | 第1非価格競争入札(億円) |
|---------|------|--------|--------|-----------|-----------|-----------|----------|----------|------------|----------|----------|------------|---------------|
| 国庫短期証券 | 1013 | - | 34,000 | 2021/8/10 | 2022/2/10 | 120,986.0 | 27,640.6 | 100.0600 | ▲0.1189% | 67.4071% | 100.0600 | ▲0.1189% | 6,359.0 |
| 物価連動10年 | 26 | 0.005% | 2,000 | 2021/8/6 | 2031/3/10 | 5,745.0 | 1,996.0 | 101.7500 | ▲0.1740% | 79.0909% | | | |

●オペ結果

| 種類 | オファー額(億円・百万ドル) | スタート日 | エンド日 | 貸付利率 | 応札総額(億円・百万ドル) | 落札総額(億円・百万ドル) | 按分レート・利回差・価格差 | 全取レート・利回差・価格差 | 平均落札レート・利回差・価格差 | 按分比率 |
|---------------------------|----------------|-----------|----------|---------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2021/8/5 | 2021/8/6 | ▲ 0.350 | 33 | 33 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2021/8/5 | 2021/8/6 | ▲ 0.350 | 0 | 0 | | | | |
| 社債等買入(残存期間1年以上3年以下) | 1250 | 2021/8/11 | | | 2,587 | 1,251 | ▲ 0.050 | | ▲ 0.034 | 26.5 |

●2021年8月6日の予定

| | | |
|-----------------------------------|---|--|
| *6月の全世帯家計調査 市場予想：消費支出、前年比+0.1% | 米国6月の消費者信用残高 米国6月の卸売売上高 米国7月の雇用統計 | *国庫短期証券(1014回)入札 (3ヶ月、50,000億円、8/10発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、8/20借入) |
| *6月の毎月勤労統計調査速報 | | |
| *6月の景気動向指数速報 | | |
| *7月のマネタリーベースと日本銀行の取引 | | |

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入